

**«Сентрас Секьюритиз» АҚ сенімгерлік басқаруындағы
«БЖЗҚ» АҚ зейнетақы активтерін
инвестициялық басқару бойынша ақпарат**

2025 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша «Сентрас Секьюритиз» АҚ (бұдан әрі – Сентрас Секьюритиз) сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтері (бұдан әрі – ЗА) 2 191,05 млн. теңгені құрап отыр.

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтері есебінен құралған қаржы құралдарының инвестициялық портфельінің құрылымы 1-кестеде берілді.

1-кесте. Қаржы құралдарының бөлігінде Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфельінің құрылымы

<i>млн.теңге</i>					
Атауы	01.01.2025 жылға ағымдағы құны	01.01.2025 жылға үлесі	01.04.2025 жылға ағымдағы құны	01.04.2025 жылға үлесі	Жыл басынан бергі өсу/төмендеу
ҚР ҚМ МБҚ	581,92	30,50%	514,80	23,50%	-11,53%
ҚР квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары	199,43	10,45%	364,47	16,63%	82,75%
ҚР ЕДБ облигациялары	175,82	9,22%	233,42	10,65%	32,76%
ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары	220,26	11,54%	463,41	21,15%	110,39%
ҚР эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары	165,39	8,67%	99,35	4,53%	-39,93%
Шетелдік эмитенттердің үлестік құралдары (ETF пайлары)	10,76	0,56%	54,78	2,50%	408,92%
Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары	108,57	5,69%	82,36	3,76%	-24,14%
АҚШ мемлекеттік облигациялары	101,78	5,33%	149,13	6,81%	46,52%
Репо	307,69	16,13%	199,02	9,08%	-35,32%
Басқа активтер (дебиторлық берешек, мерзімі өткен берешек, провизиялар)	2,37	0,12%	0,11	0,00%	-95,56%
Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат	33,90	1,78%	30,19	1,38%	-10,95%
ИПБ басқаруындағы ЗА жиынтығы	1 907,89	100,00%	2 191,05	100,00%	14,84%
Зейнетақы активтерінің жиынтығы	1 907,89	100,00%	2 191,05	100,00%	14,84%

01.04.2025 жылғы жағдай бойынша теңгемен номиналданған борыштық қаржы құралдарының орташа алынған кірістілігі – жылына 13,45%. АҚШ долларымен номиналданған қаржы құралдарының орташа алынған кірістілігі – жылына 5,15%. Жинап келгенде борыштық қаржы құралдарының жалпы орташа алынған кірістілігі – жылына 11,85%.

Инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат және кері РЕПО операциялары

Есепті кезең соңындағы инвестициялық шоттардағы ақшалай қаражат қалдығы – 30,19 млн. теңге. Олардың портфельдегі үлесі – 1,38%. Есепті кезең соңындағы РЕПО операциялары бойынша ақшалай қаражат қалдығы – 199,02 млн. теңге. Олардың портфельдегі үлесі – 9,08%. Есепті кезеңдегі кері РЕПО операцияларының орташа өлшенген кірістілігі – жылына 16,50%.

Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздары

Портфельдің негізгі үлесін алып тұрған Қазақстан Республикасы Қаржы министрлігінің мемлекеттік бағалы қағаздарының ағымдағы құны есепті ай соңында 514,80 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 23,50%. Есепті күндегі теңгемен номиналданған ҚР Қаржы министрлігінің МБҚ бойынша өтеуге орташа алынған кірістілік – жылына 14,71%. Есепті айда 1,22 млн. теңге сомасына ҚР Қаржы министрлігінің купондық МЕУКАМ сатылды.

Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары

Есепті күндегі Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдарының облигациялары бойынша өтелуі тиіс орташа өлшенген кірістілік – АҚШ долларымен жылына 5,88% және теңгемен жылына 16,13%. Қазақстан Республикасының квазимемлекеттік ұйымдары облигацияларының ағымдағы құны есепті ай соңында 364,47 млн. теңге болып отыр. Олардың портфельдегі үлесі – 16,63%. Есепті айда 96,67 млн. теңге сомасына «QazaqGaz» Ұлттық компаниясы» АҚ купондық облигациялары сатып алынды.

ҚР ЕДБ облигациялары

Есепті күндегі облигациялар бойынша өтелуі тиіс орташа өлшенген кірістілік – жылына 12,78%. Есепті ай соңында облигациялардың ағымдағы құны 233,42 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 10,65%. Есепті айда сатылып, орнына 80,92 млн. теңге сомасына «Home Credit Bank» АҚ купондық облигациялары сатып алынды.

ҚР эмитенттерінің корпоративтік облигациялары

Есепті күндегі облигациялар бойынша өтелуі тиіс орташа алынған кірістілік – жылына 11,36%. Облигациялардың ағымдағы құны есепті ай соңында 463,41 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 21,15%. Есепті айда 176,74 млн теңге сомасына Kazakhstan Utility systems LLP купондық облигациялары сатып алынды.

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Қазақстан Республикасы эмитенттерінің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны есепті ай соңында 99,35 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 4,53%. Есепті кезеңде портфель құрамынан 49,07 млн.теңге сомасына «Қазақстан Халық Банкі» АҚ, 13,81 млн. теңге сомасына «ҚазТрансОйл» АҚ, 39,58 млн. теңге сомасына «KEGOC» АҚ акциялары сатылды. Сондай-ақ, есепті айда 60,46 млн.теңге сомасына «Қазақстан Халық Банкі» АҚ GDR сатып алынды.

АҚШ мемлекеттік облигациялары

Есепті айдың соңындағы АҚШ мемлекеттік облигацияларының ағымдағы құны – 149,13 млн. теңге. Олардың портфельдегі үлесі – 6,81%. Есепті күндегі АҚШ мемлекеттік облигациялары бойынша өтелуі тиіс орташа өлшенген кірістілік – АҚШ долларымен жылына 4,23%.

Exchange Traded Funds пайлары (ETF)

Exchange Traded Funds пайларының (ETF) ағымдағы құны есепті ай соңында 54,78 млн. теңге болды. Есепті айда 14,84 млн.теңге сомасына SPDR PORTFOLIO S&P 500 ETF, сондай-ақ 29,88 млн. теңге сомасына ISHARES RUSSELL 2000 ETF сатып алынды. Портфельдегі ETF жиынтық үлесі – 2,50%.

Шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттары

Есепті айдың соңында шетелдік эмитенттердің акциялары мен депозитарлық қолхаттарының ағымдағы құны 82,36 млн. теңге болды. Олардың портфельдегі үлесі – 3,76%.

Валюталық құрылым

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ зейнетақы активтерінің есебінен сатып алынған қаржы құралдары номиналданған валюталар бөлігінде қаржы құралдарының инвестициялық портфелі 2-кестеде берілді.

2-кесте. Валюталар бөлігінде Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфелінің құрылымы

млн теңге

Валюта	01.01.2025 жылғы ағымдағы құны	01.01.2025 жылға үлесі	01.04.2025 жылға ағымдағы құны	01.04.2025 жылға үлесі	Жыл басынан бергі өсу/төмендеу
Ұлттық валюта	1 474,57	77,29%	1 675,07	76,45%	13,60%
АҚШ доллары	405,14	21,23%	515,98	23,55%	27,36%
Канада доллары	28,18	1,48%	-	-	-
Жиыны:	1 907,89	100%	2 191,05	100%	14,84%

Инвестициялық қызмет нәтижесі

Инвестициялық қызметтің және қаржы құралдарының нарықтық құнының өзгеруі нәтижесінде 2025 жыл басынан бері есептелген инвестициялық табыс мөлшері 21,54 млн. теңге болды. 2025 жыл басынан бергі зейнетақы активтерінің кірістілігі 0,92% болып отыр.

Көрсетілген кезеңдегі есептелген инвестициялық табыс құрылымы 3-кестеде берілді.

3-кесте. Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша алған инвестициялық табыс құрылымы

млн теңге

Атауы	2025 жылғы инвестициялық табыс
Бағалы қағаздар бойынша, оның ішінде орналастырылған салымдар және «кері РЕПО» операциялары бойынша сыйақы түріндегі табыс	60,13
Бағалы қағаздарды нарықтық қайта бағалаудан түскен табыс (шығын)	-33,16
Шетелдік валютаны қайта бағалаудан түскен табыс (шығын)	-6,44
Басқа активтерді қайта бағалаудан түскен табыс (шығын) (БҚК)	0,00
Сыртқы басқарудағы активтер бойынша табыс (шығын)	0,00
Басқа табыс (шығын)	1,01
Жиыны:	21,54

Шартты бірлік құны туралы ақпарат

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА шартты зейнетақы бірлігі құнының динамикасы 4-кестеде берілді.

4-кесте. Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы бір шартты бірлік құны

№	Күні	Шартты бірлік құны
1	01.03.2025	1 344,4805245
2	02.03.2025	1 344,4805245
3	03.03.2025	1 352,4352012
4	04.03.2025	1 352,4352012
5	05.03.2025	1 352,4352012
6	06.03.2025	1 352,4352012
7	07.03.2025	1 352,4352012
8	08.03.2025	1 352,4352012
9	09.03.2025	1 352,4352012

10	10.03.2025	1 352,4352012
11	11.03.2025	1 345,7698238
12	12.03.2025	1 345,7698238
13	13.03.2025	1 345,7698238
14	14.03.2025	1 345,7698238
15	15.03.2025	1 345,7698238
16	16.03.2025	1 345,7698238
17	17.03.2025	1 342,3704683
18	18.03.2025	1 342,3704683
19	19.03.2025	1 342,3704683
20	20.03.2025	1 342,3704683
21	21.03.2025	1 342,3704683
22	22.03.2025	1 342,3704683
23	23.03.2025	1 342,3704683
24	24.03.2025	1 342,3704683
25	25.03.2025	1 342,3704683
26	26.03.2025	1 349,7925396
27	27.03.2025	1 349,7925396
28	28.03.2025	1 349,7925396
29	29.03.2025	1 349,7925396
30	30.03.2025	1 349,7925396
31	31.03.2025	1 359,5645146

Инвестициялық декларация өлшемдерін сақтау туралы ақпарат

Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА құрылымдық бөлу Инвестициялық декларация талаптарына сәйкес. Валюталық позициялар үлесі рұқсат етілген деңгей шегінде қалады және Инвестициялық декларацияның талаптарын бұзбайды. 2025 жылғы 1 сәуірдегі жағдай бойынша Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау шектерін сақтау туралы мәлімет 5-кестеде берілді.

5-кесте. Сентрас Секьюритиз сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА бойынша инвестициялау шектері

№	Қаржы құралының түрі	Нақты мәні (ЗА жалпы көлемінен пайызбен)	Орындалуы (иә/жоқ)
1	Ұлттық валютадағы ақшалай қаражат – теңге (KZT)	0,31%	иә
2	Қаулыға сай басқа елдердің шетелдік валютасы	1,07%	иә
3	ҚР Қаржы министрлігі және ҚР Ұлттық Банкі шығарған ҚР мемлекеттік бағалы қағаздары (оның ішінде шетелдік мемлекеттердің заңнамасына сәйкес эмиссияланған), сондай-ақ ҚР Үкіметінің кепілімен және (немесе) кепілдігімен шығарылған БҚ	23,50%	иә
4	ҚР жергілікті атқару органдары шығарған борыштық БҚ	0,00%	иә
5	Акцияларының жүз пайызы ҚР Ұлттық Банкіне тиесілі заңды тұлға шығарған борыштық БҚ	0,00%	иә
6	ҚР және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес «Қазақстан Даму банкі», «Самұрық-Қазына» Ұлттық әл-ауқат қоры», «Бәйтерек» Ұлттық басқарушы холдингі», «Проблемалы кредиттер қоры» акционерлік қоғамдары шығарған борыштық БҚ	4,55%	иә
7	Қаулыға сай ҚР екінші деңгейдегі банктеріндегі салымдар	0,00%	иә
8	Қаулыға сай бейрезидент банктердегі салымдар	0,00%	иә

9	Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «BB+» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар төмендегі халықаралық қаржы ұйымдары шығарған борыштық бағалы қағаздар: Азиялық даму банкі (the Asian Development Bank); Америкалық даму банкі (the Inter-American Development Bank); Африкалық даму банкі (the African Development Bank); Еуразиялық даму банкі (Eurasian Development Bank); Еуропалық қайта құру және даму банкі (the European Bank for Reconstruction and Development); Еуропалық инвестициялық банк (the European Investment Bank); Еуропалық Кеңестің Даму банкі (the Council of Europe Development Bank); Ислам жеке секторды дамыту корпорациясы (the Islamic Corporation for the Development of the Private Sector); Ислам даму банкі (the Islamic Development Bank); Көпқырлы инвестициялар кепілі агенттігі (the Multilateral Investment Guarantee Agency); Скандинав инвестициялық банкі (the Nordic Investment Bank); Халықаралық валюта қоры (the International Monetary Fund); Халықаралық даму қауымдастығы (the International Development Association); Халықаралық инвестициялық дауларды реттеу орталығы (the International Centre for Settlement of Investment Disputes); Халықаралық қайта құру және даму банкі (the International Bank for Reconstruction and Development); Халықаралық қаржы корпорациясы (the International Finance Corporation).	0,00%	иә
10	Қаулыға сай шетелдік мемлекеттердің үкіметтері шығарған мемлекеттік мәртебесі бар БҚ	6,81%	иә
11	Шетелдік ұйымдар шығарған мемлекеттік емес БҚ: *Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «BB» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар шетелдік эмитенттердің акциялары; *негізгі қор индекстері құрамына кіретін шетелдік эмитенттердің акциялары және осы акциялар базалық активі болып табылатын депозитарлық колхаттар; * Standard & Poor's (Стандард энд Пурс) агенттігінің халықаралық шәкіл бойынша «BB» деңгейінен төмен емес рейтинг бағасы немесе Moody's Investors Service (Мудис Инвесторс Сервис) немесе Fitch (Фич) агенттіктерінің ұқсас деңгейдегі рейтинг бағасы бар борыштық БҚ	3,76%	иә
12	Қаулыға сай ҚР және басқа мемлекеттердің заңнамасына сәйкес ҚР ұйымдары шығарған мемлекеттік емес БҚ	57,51%	иә
13	Қаулыға сай Exchange Traded Funds (Эксчейндж Трэйдэд Фандс), Exchange, Traded Commodities (Эксчейндж Трэйдэд Коммодитис), Exchange Traded Notes (Эксчейндж Трэйдэд Ноутс) пайлары	2,50%	иә
14	Қаулыға сай қор биржасының ресми тізіміне қосылған ҚР заңнамасына сәйкес құрылған заңды тұлға басқарушы компаниясы болып табылатын интервал пайлық инвестициялық қорлардың пайлары	0,00%	иә
15	Қаулыға сай аффинирленген асыл металдар	0,00%	иә
16	Қаулыға сай хеджирлеу мақсатында жасалған туынды қаржы құралдары	0,00%	иә

«Сентрас Секьюритиз» сенімгерлік басқаруындағы БЖЗҚ ЗА инвестициялық портфеліндегі қаржы құралдарын сатып алу, сату және өтеу бойынша ақпарат

6-кесте. Есепті айдағы қаржы құралдарын сатып алу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле құны
GDR	USD	«Қазақстан Халық Банкі» АҚ	60 460 602,06
облигациялар	USD	«QazaqGaz» Ұлттық компаниясы» АҚ	96 665 636,28
ETF	USD	SPDR PORTFOLIO S&P 500 ETF	14 840 137,24
ETF	USD	ISHARES RUSSELL 2000 ETF	29 883 501,34
облигациялар	KZT	Kazakhstan Utility Systems LLP	176 741 000,00
купондық облигациялар	KZT	«Home Credit Bank» АҚ	80 923 381,87
Жиыны		-	459 514 258,79

7-кесте. Есепті айдағы қаржы құралдарын сату бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
акциялар	KZT	«ҚазТрансОйл» АҚ	13 812 899,20
акциялар	KZT	«Қазақстан Халық Банкі» АҚ	49 067 319,76
купондық МЕУКАМ	KZT	Қазақстан Республикасының Қаржы Министрлігі	1 221 973,33
қарапайым акциялар	KZT	«KEGOC» АҚ	39 575 747,54
купондық облигациялар	KZT	«Home Credit Bank» АҚ	80 923 938,25
Жиыны		-	184 601 878,08

8-кесте. Есепті айдағы бағалы қағаздар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Бағалы қағаз эмитенті	Теңгемен мәміле сомасы
-	-	-	-

9-кесте. Есепті айдағы шетелдік банктердегі салымдарға орналастыру бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Теңгемен мәміле сомасы
Есепті айда шетелдік банктердегі салымдарға орналастыру болған жоқ			
Жиыны			-

10-кесте. Есепті айдағы салымдар бойынша негізгі борышты өтеу бойынша мәлімет

Құрал түрі	Валюта	Банк атауы	Теңгемен мәміле сомасы
Есепті айда салымдар бойынша негізгі борышты өтеу болған жоқ			
Жиыны			-